

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

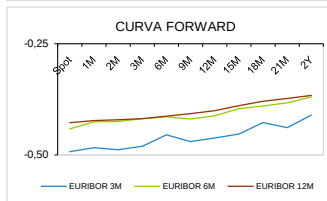
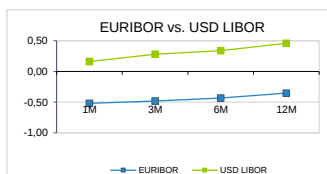
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

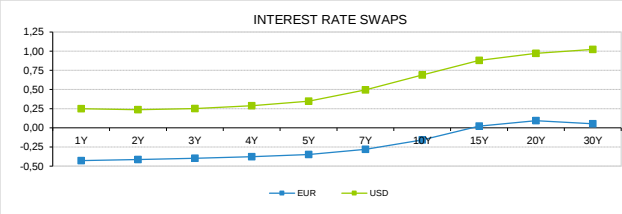
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5190	0	-1	1M	0,1619	0	-1	0,0596	-0,7814
3M	-0,4820	0	-5	3M	0,2801	2	1	0,0708	-0,7042
6M	-0,4320	0	-10	6M	0,3384	0	0	0,1241	-0,6526
12M	-0,3530	0	-8	12M	0,4585	0	-2	0,2855	-0,5152

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4275	0	-7	-0,4004	-0,3118	-0,1558
2Y	-0,4140	-1	-4	-0,3840	-0,2767	-0,1102
3Y	-0,3982	-1	-2	-0,3596	-0,2364	-0,0645
4Y	-0,3767	-1	-1	-0,3304	-0,1934	-0,0173
5Y	-0,3490	-1	-1	-0,2951	-0,1494	0,0320
7Y	-0,2800	-1	1	-0,2157	-0,0568	0,1150
10Y	-0,1577	-1	2	-0,0855	0,0660	0,2050
15Y	0,0220	-1	4	0,0724	0,1657	0,2388
20Y	0,0930	-1	5	0,1183	0,1626	0,1923
30Y	0,0521	-1	6	0,0588	0,0716	0,0768

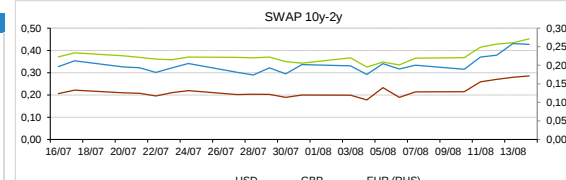
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2485	0	0	0,2253	0,4064	0,7690
2Y	0,2363	0	2	0,2507	0,4954	0,8728
3Y	0,2508	0	3	0,3010	0,5917	0,9320
4Y	0,2890	0	4	0,3718	0,6675	0,9938
5Y	0,3479	0	4	0,4560	0,7580	1,0415
7Y	0,4958	1	7	0,6125	0,8660	1,0850
10Y	0,6883	2	11	0,7895	0,9989	1,1440
15Y	0,8791	3	16	0,9300	1,0884	1,2001
20Y	0,9718	3	18	0,8680	1,1188	1,1936
30Y	1,0233	4	21	1,0463	1,0957	1,1100

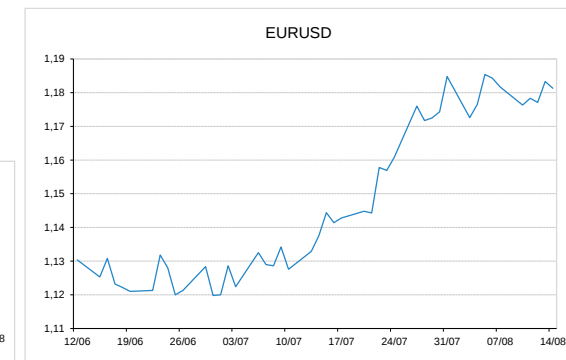
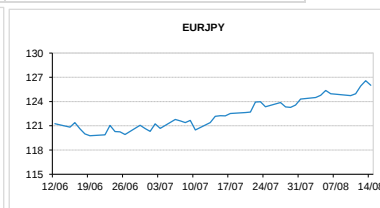
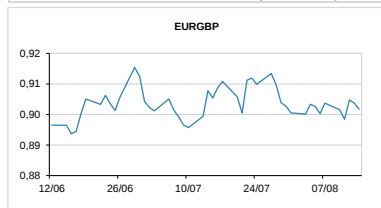


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	44,76	-0,20	1,63	OT 2Y	-0,438	-0,01	-0,70
JETFUEL	351,50	-2,25	4,76	OT 5Y	-0,154	-0,03	-7,10
DIESEL	379,25	-2,75	12,08	OT 10Y	0,373	-0,02	-5,60
COBRE	6.270,00	-176,50	-315,00	BUND 10Y	-1,118	-1,34	2,40
ZINCO	2.355,00	-28,75	100,25	SCHATZ 2Y	-0,009	-1,15	1,90
OURO	1.945,78	-8,22	136,67	T-NOTE 10Y	1,721	-1,69	1,70
TRIGO	516,00	9,50	-16,75	T-NOTE 2Y	0,752	-1,30	0,40
LICENÇA C02	25,42	-0,01	-4,22	GILT 10Y	0,274	-0,25	7,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1813	-0,17%	3,85%	1,1836	1,1862	1,1907
EUR/GBP	0,90173	0,22%	0,67%	0,9031	0,9045	0,9074
EUR/JPY	126,01	0,45%	-3,05%	126,01	126,01	126,01
EUR/CHF	1,0757	-0,08%	-0,38%	1,0750	1,0742	1,0730
EUR/BRL	6,3784	-0,56%	-4,08%	6,4062	6,4334	6,5075
EUR/PLN	4,4002	-0,01%	1,73%	4,4061	4,4139	4,4299



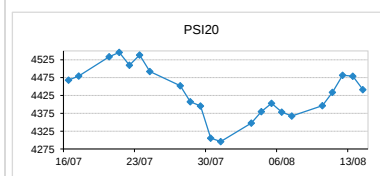
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1813	0,9017	126,01	1,0757	10,2929	7,4477	1,5681	1,65061	6,3784	10,5302
USD	0,8453	-	0,7627	106,455	0,9094	8,6999	6,2954	1,3249	1,3944	5,3910	8,8978

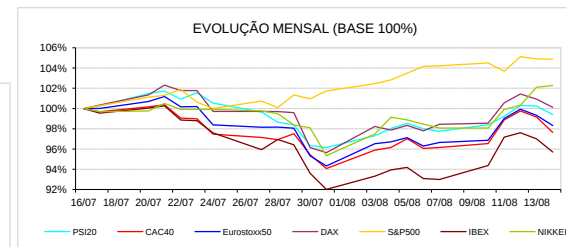
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,460	-0,22	-21,44
BCP	0,106	-0,84	-47,88
CORT. AMORIM	10,360	-0,96	-8,32
CTT	2,885	-2,21	-9,72
EDP	4,354	-0,91	15,32
EDP R	13,720	-1,44	30,67
GALP	9,528	-1,49	-36,04
IBERSOL	5,500	-1,43	-31,25
J MARTINS	14,130	-0,14	-3,61
MOTA ENGIL	1,426	3,79	-23,85
NAVIGATOR	2,302	-0,43	-33,25
NOS	3,652	-1,40	-23,92
PHAROL	0,116	0,17	16,27
RAMADA	3,520	0,00	-39,73
REN	2,485	0,40	-8,64
SEMAPA	8,070	-0,74	-41,18
SONAE CAP.	0,672	-0,30	-10,76
SONAE SGPS	0,609	-1,14	-33,13

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,79
REN	0,40
PHAROL	0,17
NOS	-1,40
IBERSOL	-1,43
EDP R	-1,44
GALP	-1,49
CTT	-2,21



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.441,40	-0,84%	-14,82%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.965,45	-1,54%	-16,95%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.308,75	-1,01%	-11,65%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.889,32	-0,80%	-2,71%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.372,18	-0,03%	4,38%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.151,80	-1,34%	-25,09%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.289,36	0,17%	-1,55%	24.115,95	16.358,19



A informação mencionada é meramente indicativa e reflecte o mercado pelas 16h30. As opiniões emitidas não podem ser entendidas como conselho ou recomendação para a prática de qualquer acto. A informação foi recolhida de fontes consideradas fiáveis, não se responsabilizando, no entanto, o CaixaBI por quaisquer incorrecções que as mesmas possam conter. Para mais informações, contactar a Sala de Mercados (Assessoria e Gestão de Risco a Empresas) do CaixaBI.

2017 © Caixa - Banco de Investimento, SA. Todos os direitos reservados.

O Caixa - Banco de Investimento, S.A. é membro da Euronext e é um intermediário financeiro registado na CMVM com o número 102.